

# Central Daily Market Report

2019年4月5日(金)

セントラル短資株式会社 総合企画部

## ●資金需給

| 単位：億円                   | 2019年4月5日<br>需給速報 | 2019年4月8日<br>需給予想 | 2019年4月9日<br>当社予想 |
|-------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| 銀行券                     | 200               | 700               | 1,000             |
| 財政                      | ▲ 5,100           | ▲ 2,000           | 2,000             |
| 資金過不足                   | ▲ 4,900           | ▲ 1,300           | 3,000             |
| <b>金融調節</b>             |                   |                   |                   |
|                         | スタート              | エンド               | スタート              |
| 貸出                      |                   |                   |                   |
| 全店共通                    |                   |                   | 5,100 ▲ 5,100     |
| 国債買現                    |                   |                   |                   |
| 国債売現                    |                   |                   |                   |
| 国庫短期証買入                 |                   |                   |                   |
| 国債買入                    |                   |                   |                   |
| CP等買入                   | 1,500 ▲ 100       |                   |                   |
| 貸出支援基金(成)               |                   |                   |                   |
| 貸出支援基金(貸)               |                   |                   |                   |
| 被災地支援<br>社債等買入          |                   |                   |                   |
| E T F 買入                | 900               | 100               |                   |
| 国債補完供給                  | ▲ 300             | 100               | 300               |
| 当預増減                    | ▲ 2,800           | ▲ 900             | 3,000             |
| 当座預金残高                  | 3,896,000         | 3,895,100         | 3,898,100         |
| 準備預金残高                  | 3,424,600         |                   |                   |
| 積み終了先                   | 3,424,400         |                   |                   |
| 超過準備                    | 3,424,400         |                   |                   |
| 非準備預金先                  | 471,400           |                   |                   |
| 4月8日以降の残り所要積立額          |                   |                   |                   |
|                         |                   |                   | 積数 1,000          |
|                         |                   |                   | 1日平均 100          |
| 積み期間 (3/16~4/15) の所要準備額 |                   |                   | 3,133,000         |
| 準備預金進捗率                 | 実績                | 99.97%            | 日数 74.19%         |

## ●2019年4月5日の市場動向

### <インターバンク市場>

本日の無担O/N物は、週末であったものの、調達意欲は限定的で、朝方は地銀・信託・証券業態を中心に▲0.086~▲0.02%の出合い。一巡後は▲0.08%近辺の出合いが散見された。ターム物は動きが乏しく、閑散であった。

### <レポ市場>

GCT/N(4/8-4/9)は、▲0.095~▲0.075%程度での出合い。SCはロールオーバーを中心に幅広い銘柄で取引が見られた。10Y334~354、5Y130~138、30Y59~61などにビッドの出入りが目立った。

### <短国市場>

現先レート(T/N)は、横ばい圏で推移した。アウトライト市場では、3M物の入札が実施された。WI取引において▲0.145%で出合い、▲0.145%の売り気配で前場引けとなる中、平均落札利回▲0.1444%、按分落札利回▲0.1400%とWI取引を反映して落ち着いた結果となった。結果発表後のセカンダリーマーケットでは、新発3M物が▲0.170~▲0.150%の出合いと強含みで推移した。

### <CP市場>

現先レートは低位で推移した。CP発行市場は、卸売業態で大型案件がみられ、償還総額100億円程度に対して、発行総額は1,000億円程度と発行超となった。発行レートは、概ね横ばい圏で推移した。

## ●短期金融市場関連指標

| 2019/4/5 | 無担(速報)  |         |         | 有担(速報) |    |    | 短国<br>売買参考統計値 | 東京<br>レポレート<br>平均値 | JGB新発10年債 |           | 日経平均株価    |           | ドル/円      |           |
|----------|---------|---------|---------|--------|----|----|---------------|--------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|-----------|
|          | 単位：%    | 最低      | 最高      | 平均     | 最低 | 最高 |               |                    | 平均        | 直近値       | 前日比       | 15時時点     | 前日比       | 為替(9時)    |
| O/N      | ▲ 0.150 | 0.001   | ▲ 0.063 |        |    |    | -             | ▲ 0.094            | ▲ 0.035   | 0.008     | 21,807.50 | 82.55     | 111.65-66 | 111.67-68 |
| T/N      |         |         |         |        |    |    | -             | ▲ 0.094            |           |           |           |           |           |           |
| S/N      |         |         |         |        |    |    | -             | -                  |           |           |           |           |           |           |
| 1W       | ▲ 0.050 | ▲ 0.032 | ▲ 0.039 |        |    |    | -             | ▲ 0.093            |           |           |           |           |           |           |
| 2W       |         |         |         |        |    |    | -             | ▲ 0.100            |           |           |           |           |           |           |
| 3W       |         |         |         |        |    |    | -             | ▲ 0.118            |           |           |           |           |           |           |
| 1M       |         |         |         |        |    |    | -             | ▲ 0.124            |           |           |           |           |           |           |
| 3M       | ▲ 0.030 | 0.180   | ▲ 0.023 |        |    |    | ▲ 0.170       | ▲ 0.133            |           |           |           |           |           |           |
| 6M       |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.160       | ▲ 0.153            |           |           |           |           |           |           |
| 1Y       |         |         |         |        |    |    | ▲ 0.168       | ▲ 0.157            |           |           |           |           |           |           |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | 日付        | 3/29      | 4/1       | 4/2       | 4/3       | 4/4       |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | 日銀当預残     | 3,940,300 | 3,923,300 | 3,904,800 | 3,886,000 | 3,898,800 |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | 準備預金残     | 3,462,500 | 3,425,200 | 3,411,900 | 3,414,500 | 3,435,600 |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | マネタリーベース  | 5,064,400 | 5,046,700 | 5,027,700 | 5,008,300 | 5,021,600 |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | 無担O/N加重平均 | ▲0.060%   | ▲0.067%   | ▲0.067%   | ▲0.066%   | ▲0.063%   |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | コール市場残高   | 51,166    | 95,607    | 100,586   | 102,882   | 94,109    |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | うち無担      | 41,283    | 68,089    | 73,295    | 76,114    | 70,610    |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | うちO/N     | 28,623    | 46,979    | 49,385    | 50,349    | 44,375    |
|          |         |         |         |        |    |    |               |                    | うち有担      | 9,883     | 27,518    | 27,291    | 26,768    | 23,499    |

## ●入札結果

| 名称     | 回号  | 表面利率 | 発行予定額  | 発行日      | 償還日       | 応募額(億円)   | 募入額(億円)  | 募入最低額    | 募入最高利回・利回較差 | 案分率      | 募入平均価格   | 募入平均利回・利回較差 | 第1非価格競争入札(億円) |
|--------|-----|------|--------|----------|-----------|-----------|----------|----------|-------------|----------|----------|-------------|---------------|
| 国庫短期証券 | 824 | -    | 43,400 | 2019/4/8 | 2019/7/16 | 133,238.0 | 35,211.7 | 100.0380 | ▲0.1400%    | 62.8055% | 100.0392 | ▲0.1444%    | 8,188.0       |

## ●オペ結果

| 種類                        | オファー額(億円・百万ドル) | スタート日    | エンド日      | 貸付利率 | 応札総額(億円・百万ドル) | 落札総額(億円・百万ドル) | 按分レート・利回較差・価格較差 | 全取レート・利回較差・価格較差 | 平均落札レート・利回較差・価格較差 | 按分比率 |
|---------------------------|----------------|----------|-----------|------|---------------|---------------|-----------------|-----------------|-------------------|------|
| 共通担保資金供給(全店)<固定金利方式>      | 15,000         | 2019/4/8 | 2019/4/22 |      | 5,131         | 5,131         |                 |                 |                   |      |
| 国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分) | 31,108         | 2019/4/5 | 2019/4/8  |      | 330           | 330           |                 | ▲0.600          | ▲0.600            |      |

## ●2019年4月8日の予定

|  |                              |                     |
|--|------------------------------|---------------------|
| *日銀支店長会議 さくらレポート<br>(地域経済報告)<br>*2月の国際収支 | *3月の消費動向調査<br>*3月の景気ウォッチャー調査 | *米国2月の製造業新規受注・出荷・在庫 |
|--|------------------------------|---------------------|

◆本資料は信頼できると思われる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何かの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はおお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目録見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入